



## デイリーシグナル

2022年3月14日(月)

### 短期市場の推移

	3月8日	3月9日	3月10日	3月11日
加重平均金利	▲0.007	▲0.007	▲0.008	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.083	▲0.086	▲0.086	▲0.085
無コール残	159,427	183,964	186,585	180,137
ON	82,084	104,831	101,432	101,149
その他	77,343	79,133	85,153	78,988
有コール残	28,909	28,386	28,567	29,081

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表  
※加重平均金利は無担保コールONのもの、無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

### 本日の短期市場金利

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.060	0.001	▲0.011	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.005	▲0.085
2W	-	-	▲0.004	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.104
1Y	-	-	-	▲0.112

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

### 3月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)3月NY連銀製造業景気指数	7.8
-	-	21:30 (米)2月生産者物価コア指数[前年比]	8.7%
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.005%のレンジで推移した。先週末に引き続き一部ビッドサイドで調達意欲の弱まりが見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.011%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.008 ~ ▲0.008	▲0.020 ~ ▲0.001

### 翌営業日のマーケット

積み最終日ではあるものの、調達動向に大きな変化は見られず、出合の水準は本日と同程度を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月14日		3月15日		3月16日	
券	+400		+300		+0	
財政	+5,100		+2,200		+5,000	
過不足	+5,500		+2,500		+5,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買戻先					▲40,000	
共通担保(全店)					▲2,600	
CP等買入	▲400		▲800		+5,000	
国債補完供給	+100	▲100	+100			
貸出増加支援					▲27,800 +38,900	
当座預金増減	+5,100		+1,800		▲21,500	
当座預金残高	5,325,000		5,326,800		5,305,300	
準備預金残高	4,697,700		4,697,700		主な需給要因	
積み終了先	4,697,700				流動性供給	
超過準備	4,697,700					
非準備先残高	627,300					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.4%					
乖離率	3.6%					

### 3月14日のオペ結果

【%】(億円)※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(3/14~3/15)	116	116	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
3月11日時点 6,564,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,406,600
3月15日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

### 国債短期証券入札予定

3月16日	1年 (第1066回)
3月17日	3ヶ月(第1067回)
3月24日	6ヶ月
3月25日	3ヶ月

### 国債入札予定

3月29日	40年
3月31日	2年
4月5日	10年
4月7日	30年

### 今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	月1回	3月2日	0
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 23	3月9日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 23 30	3月2日	2
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 23 30	3月9日	3
10年超25年以下	1500	1,500	2	3月2日	0
25年超	500	500	16	2月16日	1
物価連動債	600	600	月1回	2月24日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月20日	-

### 1年前の市場推移

○2021年2月積み期 [2月16日~3月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会